

Т.В. Меркулова, д-р экон. наук

Харьковский национальный университет имени В.Н. Каразина

ЭКОНОМИЧЕСКИЙ РОСТ И НЕРАВЕНСТВО: ИНСТИТУЦИОНАЛЬНЫЙ АСПЕКТ И ЭМПИРИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ

Рассмотрены основные гипотезы и теоретические положения, обосновывающие взаимосвязь между уровнем экономического развития и неравенством в распределении доходов. Показана роль институциональных факторов, оказывающих существенное влияние на характер и силу этой связи. Изложены результаты эмпирического анализа с учётом индекса HDI, которые уточняют некоторые выводы предшествующих исследований.

Фокусом данной многогранной проблематики является вопрос о существовании и характере связи между экономическим ростом (развитием) и социальным неравенством. Исследование этого вопроса имеет длительную историю теоретического анализа и эмпирических обоснований. Не ставя задачу исчерпывающего анализа исследований в данной области¹, остановимся на некоторых результатах, имеющих значение для нашей работы, которая сфокусирована на одном аспекте этой проблематики: взаимосвязи между экономическим развитием и неравенством в распределении дохода в обществе.

Базовым результатом, который лежал в основе господствующего теоретического обоснования данной связи до начала 80-х годов прошлого века, является гипотеза С.Кузнецца, согласно которой экономический рост сначала сопровождается усилением неравенства в распределении дохода, а затем ведёт к его уменьшению (кривая Кузнецца имеет форму, обратную U-образной кривой)². Многочисленные эмпирические проверки, проводившиеся зарубежными исследователями на материалах различных выборок по развивающимся и развитым странам, находили подтверждение этой гипотезы³.

Однако результаты этих исследований впоследствии были подвергнуты критическому анализу, и под сомнение были поставлены два базовых теоретических положения: а) экономический рост ведёт сначала к усилению, а затем к уменьшению неравенства; б) высокая дифференциация доходов стимулирует более высокие темпы роста. В конце прошлого века экономическая жизнь предоставила достаточно примеров развития, которые говорят об ограниченности этих представлений: экономический рост

¹ Обширный обзор можно найти, напр.: *Bigsten A., Levin J. Growth, Income Distribution, and Poverty: A Review* // WIDER Discussion Paper 129. World Institute for Development Economics research (WIDER), Helsinki, November 2001.

² *Kuznets S. Economic growth and Income inequality* // *American Economic Review*. – 1995. – March. – P. 1–28.

³ См.: *Ahluwalia M. Inequality, Poverty and Development* // *Journal of Development Economics*. – 1976. – № 3 (4). – December. – P. 307–342.

сопровождался и усилением, и ослаблением неравенства, а высокие темпы роста достигались при изначально невысокой дифференциации доходов.

В ряде зарубежных исследований новых данных учёные приходят к выводу, что гипотезу Кузнецца следует, скорее, отклонить: экономический рост может сопровождаться снижением, увеличением или консервацией неравенства⁴. Исследователи отмечают примеры, когда увеличение неравенства происходило на фоне не роста, а падения (страны Восточной Европы и Центральной Азии в период 1985–1995 годов)⁵, а также примеры негативного влияния неравенства на экономический рост⁶.

Мощный импульс исследования взаимосвязи роста и неравенства получили в связи с актуализацией проблемы бедности, разработкой и реализацией международных программ сокращения бедности⁷. Именно на решение этой проблемы следует направить усилия в соответствии с рекомендациями представителей либерального направления экономической теории, которое рассматривает позитивную роль неравенства в распределении доходов, признавая его необходимой составляющей экономического роста.

Современные представления в данной области можно свести к следующим основным выводам: 1) в результате эмпирического анализа не удалось обнаружить систематической связи между экономическим ростом (независимо от его измерения: через ВВП на душу населения или через средний доход домохозяйств) и неравенством в распределении дохода; 2) уровень начального неравенства не является устойчивым объясняющим фактором роста; 3) экономический рост является необходимым, но не достаточным условием сокращения бедности и неравенства: важен не столько темп роста, сколько его качество (broad-based growth)⁸.

Данные выводы свидетельствуют о необходимости и важности включения в анализ институциональных факторов, которые опосредуют взаимосвязь между экономическим ростом и распределением дохода и существенно влияют на характер и силу связи.

⁴ См.: *Milanovic B.* Determinants of Cross-Country Income Inequality: An Augmented Kuznets Hypothesis // World Bank Policy Research Working Paper 1246. World Bank, Washington, D.C., 1994; *Ravallion M., Lyn S., Michael B.* Equity and Growth in Developing Countries: Old and New Perspectives on the Policy Issues // Policy Research Working Paper 1563. World Bank, Washington, D.C., January 1996; *Deininger K., Lyn S.* A New Data Set Measuring Income Inequality // World Bank Economic Review. – 1996. – September. – № 10 (3). – P. 565–591.

⁵ *Adams R.* Economic growth, inequality, and poverty – findings from a new data set // World Bank Policy Research Working Paper. – No. 2972. – Washington, D.C.

⁶ *Bigsten A., Levin J.* Growth, Income Distribution, and Poverty.

⁷ *Ravallion M.* Can High-inequality Developing Countries Escape Absolute Poverty? // World Bank Policy Research Working Paper 1775. World Bank, Washington, D.C., 1997; *Lustig N., Rigolini J., Arias O.* Poverty Reduction and Economic Growth: A Two-Way Causality // Sustainable Development Department Technical Papers Series 111. Inter-American Development Bank, Washington, D.C., March 2002.

⁸ *Fields G.* Distribution and Development: A New Look at the Developing World. Cambridge, Russell Sage Foundation and MIT Press, January 2001.

Учитывая это, некоторые исследователи выделяют уровень неравенства, обусловленный влиянием экономических факторов, в соответствии с гипотезой Кузнецца (*given inequality*), и отклонение от этого «данного» (экзогенного) уровня, которое происходит вследствие факторов, связанных с экономической политикой государства. Утверждается, что расхождение между реальным неравенством и тем, которое обусловлено кривой Кузнецца, расширяется по мере развития общества. Неравенство в высокодоходных странах уменьшается не только по экономическим причинам, но и потому, что общество сознательно выбирает уменьшение неравенства по мере того, как становится богаче⁹.

В рамках мейнстрима связь между экономическим ростом и распределением дохода раскрывается через критерий экономической эффективности. Исследование этого вопроса на институциональной платформе приводит к необходимости включения в анализ критерия социальной справедливости – первой добродетели институтов, по выражению Дж.Роулза.

Понятия неравенства и справедливости тесно связаны. Любые формы социального неравенства оцениваются в обществе по критерию справедливости и в зависимости от этой оценки могут быть источником конфликтов или согласия и, соответственно, увеличения или экономии трансакционных издержек. Господствующие в обществе представления о справедливости предопределяют некоторый уровень неравенства в распределении доходов, который признается обществом как норма. Именно по отношению к этой норме дифференциацию доходов населения можно признать чрезмерной или недостаточной. Следует подчеркнуть, что отклонение от этой нормы в любую сторону оказывает негативное влияние на экономическое развитие.

Усиление дифференциации доходов приводит к ухудшению качества социального капитала: во-первых, затрудняет обеспечение равных возможностей всем членам общества; во-вторых, вступая в противоречие с представлениями о справедливости, усиливает социальную напряжённость в обществе; в-третьих, подрывает трудовую и предпринимательскую мотивацию (справедливо отмечается, что чрезмерный разрыв в доходах подрывает мотивацию к рациональной и производительной деятельности¹⁰). Отклонение неравенства от нормы в сторону уменьшения ослабляет стимулы к активности, нарушая через перераспределение доходов принцип равенства по отношению к наиболее предприимчивым и способным членам общества и тем самым подрывая потенциал экономического развития.

⁹ См.: *Milanovic B. Determinants of Cross-Country Income Inequality.*

¹⁰ Институциональная архитектура и динамика экономических преобразований. – Харьков, 2008. – С. 431.

Таким образом, уровень неравенства, который признаётся обществом справедливым и в этом смысле нормой, является одновременно оптимальным, при котором происходит экономия транзакционных издержек и экономическое развитие достигает максимума при прочих равных условиях. Относительно этого уровня неравенства можно сделать два замечания.

Во-первых, очевидно, что норма неравенства не может быть единой для всех, поскольку она отражает актуальные в данном периоде для конкретного общества критерии справедливости, а значит, зависит от времени и места. Вместе с тем, во-вторых, норма должна обладать достаточной устойчивостью во времени, так как представления о справедливости в обществе меняются эволюционно, на протяжении нескольких поколений. Слабая изменчивость во времени неравенства доходов отмечается в ряде исследований, например, за период 1985–1995 годов важнейший показатель экономического роста ВВП на душу населения увеличился в развивающихся странах на 26%, а основной показатель неравенства распределения доходов – коэффициент Джини – на 0,28% в год¹¹. Устойчивость этого показателя используется исследователями в качестве аргумента при обосновании позитивного влияния экономического роста на сокращение бедности: поскольку распределение дохода остаётся стабильным, увеличение среднего дохода (или ВВП на душу населения) приводит к улучшению положения всех слоев общества, в том числе бедных¹².

В рамках одной страны причиной устойчивости показателей, отражающих неравенство, может быть именно незыблемость в течение продолжительных интервалов времени принципов справедливости, принятых в обществе, а значительные изменения в уровне неравенства происходят в периоды смены представлений о справедливости. Косвенным подтверждением этого тезиса могут служить примеры постсоветских стран, в которых радикальные изменения затронули не только экономику, но и всю общественную жизнь, вызвав существенные сдвиги представлений о морали и справедливости. В этих странах наблюдается значительный рост неравенства на фоне негативной траектории ВВП.

Итак, изменчивость степени неравенства доходов заметна именно в межстрановых сравнениях, так как при этом элиминируется влияние инерционности данного показателя для отдельных стран. Поэтому если связь между экономическим развитием и неравенством существует, то её характер и сила должны проявиться на

¹¹ Adams R. Economic growth, inequality, and poverty – findings from a new data set.

¹² Dollar D., Aart K. Growth is Good for the Poor. World Bank Policy Research Working Paper. – No 2587, Washington, DC.

временном срезе: при сопоставлении разных стран в одном периоде. В анализе взаимосвязи показателей неравенства и уровня экономического развития следует учитывать институциональные факторы, которые в соответствии с исходной посылкой могут влиять на тип и силу связи.

Обратимся к эмпирическому анализу, который состоит из трёх этапов: анализ неструктурированной выборки стран; анализ связи внутри выделенных групп; анализ скорректированного коэффициента Джини.

Первый этап. Оценка взаимосвязи дифференциации доходов и уровня развития проводилась по выборке, включающей данные за 2000 год по 43 странам разных регионов мира¹³. Для оценки неравенства в распределении доходов населения использован коэффициент Джини (G), в качестве индикаторов уровня развития страны – индекс ВВП на душу населения (GDP index) и индекс развития человека (HDI), который рассчитывается на основе ВВП на душу населения, средней продолжительности жизни и уровня образованности населения, что обуславливает тесную связь между ними (рис. 1).

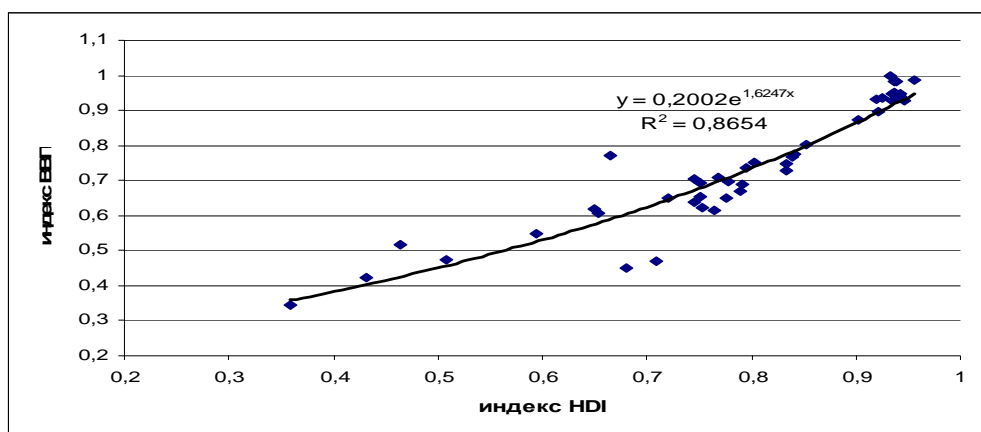


Рисунок 1. Зависимость между индексами ВВП и HDI

При невысоких значениях наблюдается существенный разброс HDI при одной и той же величине индекса ВВП. Поскольку HDI не только отражает экономический аспект развития, но и учитывает социальные факторы и косвенно отражает ориентиры экономической политики государства, такой разброс говорит о возможностях повышения общественного благосостояния и развития в одних и тех же рамках экономического роста: достижение определённого уровня ВВП на душу населения может быть использовано или не использовано для улучшения условий жизни членов общества.

¹³ См.: <http://world.bank.org.ua>; <http://epp.eurostat.ec.europa.eu>.

Анализ полной выборки стран показывает слабую отрицательную связь между коэффициентом Джини и индексом ВВП (коэффициент корреляции $R = -0,22$) (рис. 2). С индексом HDI – картина аналогичная.

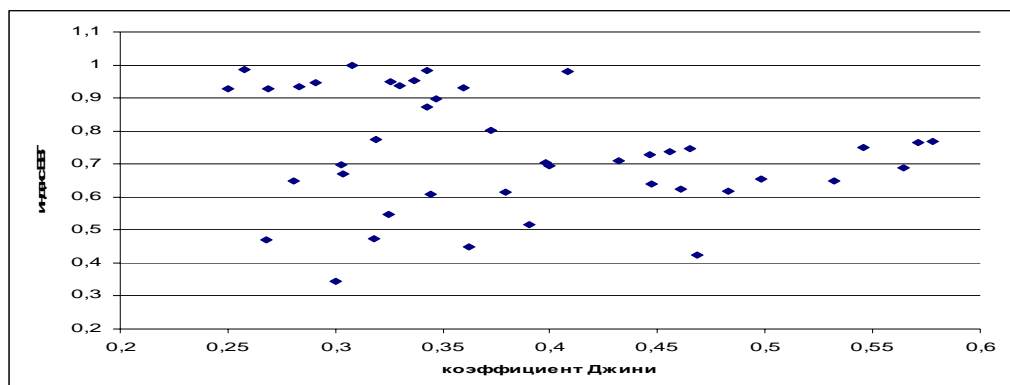


Рисунок 2. Зависимость между коэффициентом Джини и индексом ВВП

Этот результат подтверждает вывод предшествующих исследований, проведенных на основе данных 1990-х годов, об отсутствии значимой связи между неравенством и уровнем развития без учёта институциональных факторов.

Институциональные факторы отражает индекс развития HDI, и далее – *на втором этапе* – мы анализируем структурированную совокупность стран по выделенным в соответствии с этим показателем группам (табл. 1).

Таблица 1

Группировка стран по уровню развития*

Уровень развития	№	Страна	Индекс HDI	Индекс Джини
Высокий	1	Норвегия	0,956	0,258
	2	Швеция	0,946	0,25
	3	Канада	0,943	0,326
	4	Бельгия	0,942	0,33
	5	США	0,939	0,408
	6	Ирландия	0,936	0,343
	7	Швейцария	0,936	0,337
	8	Финляндия	0,935	0,269
	9	Австрия	0,934	0,291
	10	Люксембург	0,933	0,308
	11	Германия	0,925	0,283
	12	Испания	0,922	0,347

	13	Италия	0,92	0,36
	14	Греция	0,902	0,343
	15	Эстония	0,853	0,372
	16	Литва	0,842	0,319
	17	Чили	0,839	0,571
	18	Коста-Рика	0,834	0,465
	19	Уругвай	0,833	0,446
	20	Мексика	0,802	0,546
Средний	21	Россия	0,795	0,456
	22	Панама	0,791	0,564
	23	Беларусь	0,79	0,304
	24	Румыния	0,778	0,303
	25	Украина	0,777	0,281
	26	Таиланд	0,768	0,432
	27	Ямайка	0,764	0,379
	28	Филиппины	0,753	0,461
	29	Перу	0,752	0,498
	30	Турция	0,751	0,4
	31	Тунис	0,745	0,398
	32	Китай	0,745	0,447
	33	Сальвадор	0,72	0,532
	34	Узбекистан	0,709	0,268
	35	Молдова	0,681	0,362
	36	Южная Африка	0,666	0,578
	37	Египет	0,653	0,344
	38	Гватемала	0,649	0,483
	39	Индия	0,595	0,325
	40	Бангладеш	0,509	0,318
Низкий	41	Мавритания	0,465	0,39
	42	Руанда	0,431	0,468
	43	Эфиопия	0,359	0,3

* Составлено по материалам: <http://world.bank.org.ua>; <http://epp.eurostat.ec.europa.eu>.

Статистический анализ связи между коэффициентом Джини и индексами ВВП и HDI дал существенно отличающиеся по группам результаты (табл. 2).

Таблица 2

Характеристика связи между показателями неравенства и развития

Группы стран	Коэффициент корреляции		
	Между G и HDI	Между G и GDP index	Между Gg и GDP index
Группа 1 Высокий уровень	- 0,78	- 0,69	- 0,78
Группа 2 Средний уровень	+0,16	+0,52	+ 0,26
Полная выборка	- 0,22	- 0,22	- 0,68

В группе высокоразвитых по индексу HDI стран ($HDI \geq 0,8$) наблюдается тесная отрицательная связь между ним и коэффициентом Джини: усиление неравенства в распределении доходов сопровождается снижением уровня развития (рис. 3).

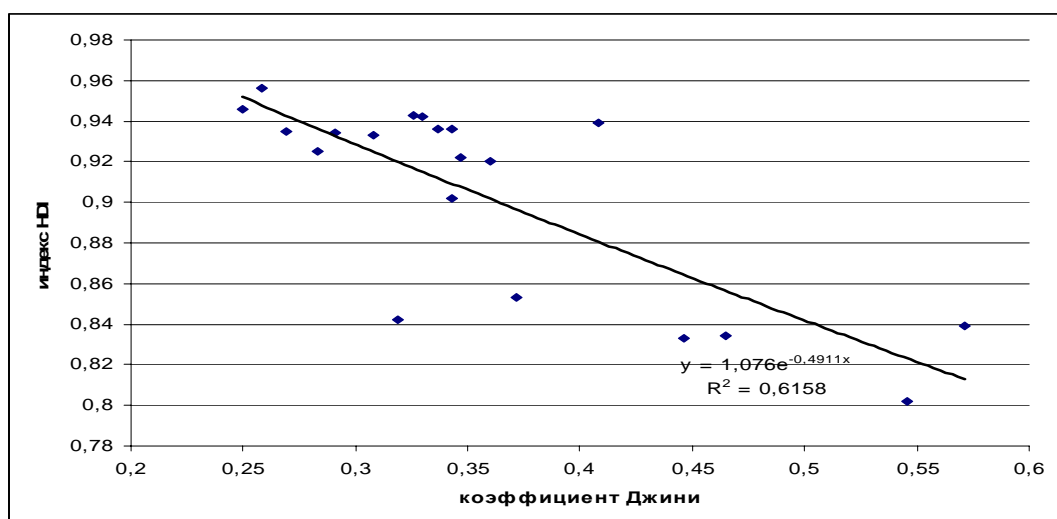


Рисунок 3. Связь между коэффициентом Джини и индексом HDI в группе высокоразвитых стран

Аналогичен характер связи между коэффициентом Джини и индексом ВВП (рис. 4). В группе среднеразвитых стран ($0,8 > HDI \geq 0,5$) связь неравенства с индексом развития слабая ($R = 0,16$), с индексом ВВП более сильная ($R = 0,52$).

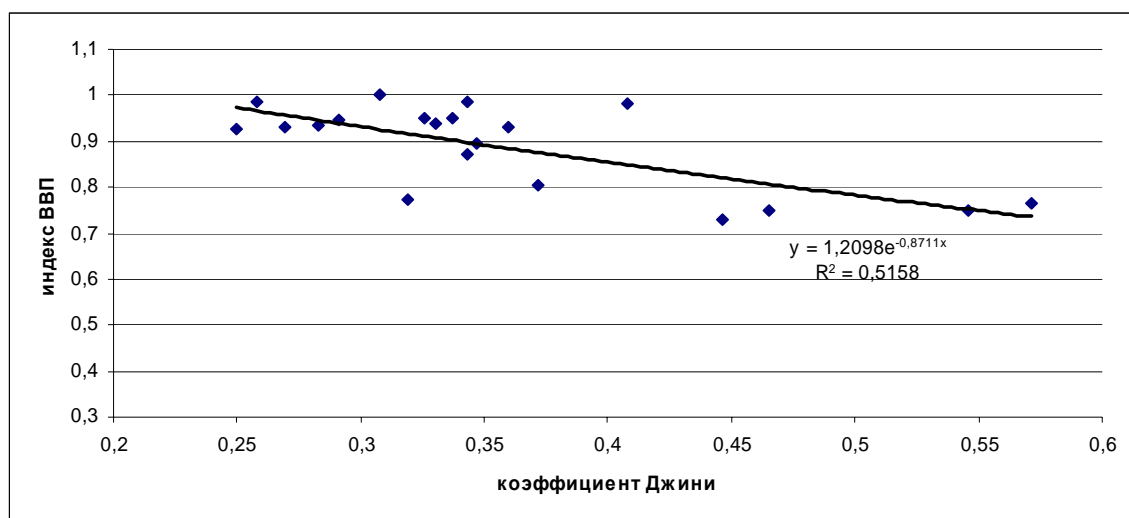


Рисунок 4. Связь между коэффициентом Джини и индексом ВВП в группе высокоразвитых стран

Но важнее другое обстоятельство: в этой группе характер связи меняется с отрицательного на положительный, то есть наблюдается однонаправленность изменения показателя неравенства распределения дохода и индексов развития (рис. 5).

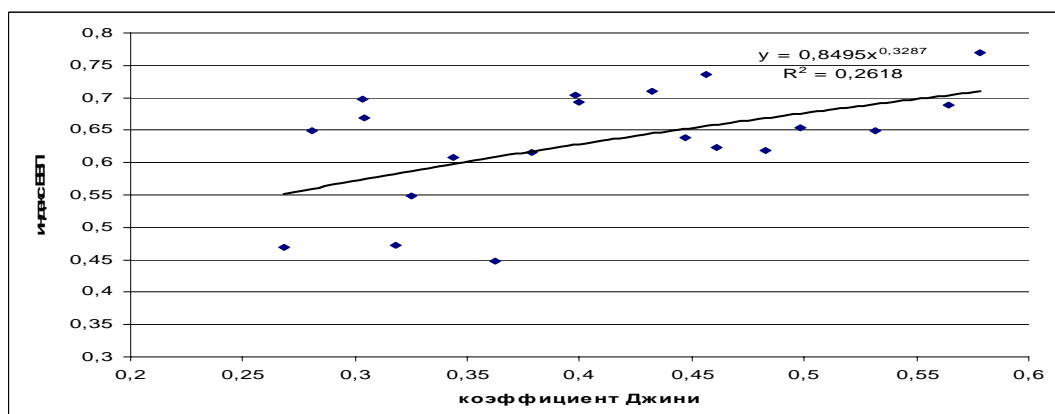


Рисунок 5. Связь между коэффициентом Джини и индексом ВВП в группе среднеразвитых стран

Третий этап анализа представляет собой попытку синтеза на основе индексов Джини и HDI некоторого индикатора, который отражал бы уровень развития с учётом степени неравенства распределения доходов.

Рассмотрим показатель, который получается путём деления коэффициента Джини на индекс HDI $Gg = G : HDI$. Его можно назвать скорректированным коэффициентом

Джини. Интерпретация этого показателя достаточно прозрачна и может быть прокомментирована с двух позиций (неравенства и развития). С одной стороны, если две страны имеют одинаковый коэффициент Джини, но у одной из них меньше индекс HDI, то скорректированный коэффициент отразит это различие: он будет больше у страны с меньшим уровнем развития. Таким образом, неравенство оценивается с учётом его «полезного эффекта» для социального развития, уровень которого отражается индексом HDI. С другой стороны, при ранжировании по обратному индексу HDI в начале списка располагаются страны с более низкой оценкой ($1/HDI$), которая повышается в соответствии с коэффициентом Джини, то есть при равенстве индексов развития страна с более сильным расслоением доходов получит более высокую оценку и, соответственно, займёт более низкое место в списке.

Ранжирование полной выборки по возрастанию скорректированного коэффициента Джини даёт примечательный результат (табл. 3).

Таблица 3

Ранжирование стран по скорректированному коэффициенту Джини

№	Страна	Коэффициент Джини (G)	Индекс HDI	G/HDI
1	Швеция	0,25	0,946	0,264
2	Норвегия	0,258	0,956	0,270
3	Финляндия	0,269	0,935	0,288
4	Германия	0,283	0,925	0,306
5	Австрия	0,291	0,934	0,312
6	Люксембург	0,308	0,933	0,330
7	Канада	0,326	0,943	0,346
8	Бельгия	0,33	0,942	0,350
9	Швейцария	0,337	0,936	0,360
10	Украина	0,281	0,777	0,362
11	Ирландия	0,343	0,936	0,366
12	Испания	0,347	0,922	0,376
13	Узбекистан	0,268	0,709	0,378
14	Литва	0,319	0,842	0,379
15	Греция	0,343	0,902	0,380
16	Беларусь	0,304	0,79	0,385
17	Румыния	0,303	0,778	0,389
18	Италия	0,36	0,92	0,391

19	США	0,408	0,939	0,435
20	Эстония	0,372	0,853	0,436

Первые 20 стран совпадают по составу с высокоразвитой по индексу HDI группой (табл. 1), за исключением четырёх стран: выбыли латиноамериканские страны – Чили, Коста-Рика, Мексика и Уругвай, а их место заняли постсоветские – Украина, Беларусь, Узбекистан, а также Румыния. Соотношение индексов неравенства и развития в этих странах близко к значениям этого показателя для развитых стран.

Анализ корреляции между индексом ВВП и скорректированным коэффициентом Джини показал существенную отрицательную связь между этими показателями на полной выборке стран ($R = -0,68$), что вполне объяснимо, так как в знаменателе скорректированного коэффициента Джини стоит показатель, зависящий от ВВП (рис. 6).

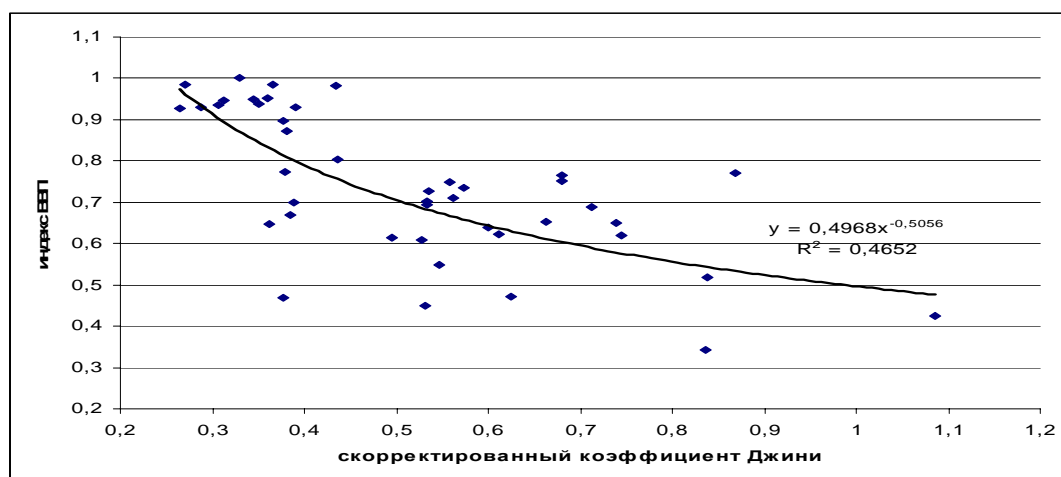


Рисунок 6. Скорректированный коэффициент Джини и индекс ВВП

Однако при этом по группам стран результаты противоположные: в первой группе наблюдается тесная отрицательная связь, а во второй – связь положительная, но более слабая (табл. 2)¹⁴.

По результатам проведённого анализа некоторые выводы предшествующих исследований можно уточнить. Во-первых, заключение об отсутствии статистически значимой связи между экономическим ростом и распределением дохода справедливо только для стран со средним и низким уровнем развития по индексу HDI. В высокоразвитых странах выявлено наличие тесной отрицательной связи между

¹⁴ Скорректированный коэффициент Джини – это, скорее, предложенный подход к конструированию показателя, поэтому его окончательный вариант и формальные аспекты построения здесь не обсуждаются.

показателями экономического роста (ВВП на душу населения) и неравенства. Во-вторых, вывод о том, что начальное неравенство не имеет значения для экономического роста, может быть интерпретирован таким образом. Поскольку границы изменения коэффициента Джини в разных по индексу HDI группах почти одинаковы, то две страны с близкими (равными) значениями коэффициента Джини могут оказаться в разных группах развития по HDI и тогда экономический рост будет сопряжён у них с разнонаправленным изменением неравенства. Таким образом, имеет значение начальный уровень не дифференциации доходов, а гуманитарного развития.

Тезис об оптимальном уровне неравенства получил косвенное эмпирическое подтверждение – это значение, при котором индекс HDI страны достигает границы высокоразвитой группы, и далее рост сопровождается уже снижением неравенства при условии, что страна остаётся в высокоразвитой группе.

Соотношение между уровнем неравенства и индексом гуманитарного развития может быть отражено с помощью скорректированного коэффициента Джини. Этот коэффициент достаточно тесно коррелирует с экономическим ростом, причём связь имеет отрицательный знак, то есть улучшение этого соотношения (уменьшение скорректированного коэффициента) сопровождается экономическим ростом. С этой точки зрения важным представляется степень дифференциации доходов именно в соотнесении с уровнем гуманитарного развития, который отражает определённые приоритеты социально-экономической политики государства.

Экономическая теория, №1, 2009, с. 81-90.